

ISIN	RATING FITCH	IMPORTO	EMITTENTE	CEDOLA %	CEDOLE	COSTO LOMBARD	PREZZO ACQUISTO	PREZZO 16/9	DIFFERENZA QUOTAZIONE
US61747YFB65	A+ (21/05/25)	150000	MORGAN STANLEY	5,948	994	432	103	105,5	3085
US404280AW98	A+ (28/8/24)	200000	HSBC	4,3	958	559	99,85	100,03	306
USF8500RAD47	A- (4/6/25)	200000	SOC. GENERALE AT1	8,5	1895	591	105,7	107,7	3207
XS3070657203	A+ (22/11/24)	200000	ENI	5,75	1282	565	101	104,8	6377
US87927VAV09	NR	175000	TELECOM ITALIA	7,721	1506	529	108	111	4120
US61747YET82	A+ (21/05/25)	200000	MORGAN STANLEY	4,679	1043	559	100	100	0
US46647PDG81	AA+ (3/6/25)	200000	JP MORGAN	4,851	1081	564	100,8	101,52	1211
US06738EBX22	A (10/6/25)	200000	BARCLAYS AT1	8,00	1783	594	106,1	106,49	623
US404280BX62	A+ (28/8/24)	200000	HSBC	4,292	957	559	99,85	100	255
US539439AW91	A+ (21/11/24)	200000	LLOYDS	7,95	1773	639	114,2	117,34	4660
XS2559133363	BBB (31/10/24)	200000	INTESA	8,25	1838	642	114,7	118,83	6103
US404280DS59	A+ (28/8/24)	200000	HSBC	8,113	1808	644	115,2	118,1	4267
USF8500RAC63	A- (4/6/25)	200000	SOC. GEN. AT1	9,375	2090	598	106,8	107,23	682
US639057AT53	A (21/11/24)	200000	NATWEST (EX RBS) AT1	7,3	1627	576	103	105,3	3785
US87927VAF58	NR	160000	TELECOM ITALIA	6,375	1137	465	103,8	104,2	523
TOTALE					21772				39202
COSTO LOMBARD						8515			
DIFFERENZA CEDOLE	COSTO LOMBARD	13257							
DIFFERENZA	QUOTAZIONE								39202
GUADAGNO TOTALE									52459
IMPORTO INVESTITO							3001463		
GUADAGNO %	ASSOLUTO								1,748%
GUADAGNO % SU	BASE ANNUA								22,985%

GIORNI PASSATI	48
COSTO LOMBARD	2,51
CAMBIO €/ \$	1,18